

เอกสารอ้างอิง

- ณัฐวุฒิ ชังเควี. 2546. การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหุ้นธุรกิจโรงแรมและการท่องเที่ยวโดยวิธีการถดถอยแบบสลับเปลี่ยน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. 2542. รู้จักกับตลาดหลักทรัพย์. กรุงเทพฯ: ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย.
- ทรงศิริ แต่สมบัติ. 2541. การวิเคราะห์การถดถอย. พิมพ์ครั้งที่ 2. กรุงเทพฯ : สำนักพิมพ์มหาวิทยาลัยเกษตรศาสตร์.
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์ และอารี วิบูลย์พงศ์. 2543. “การประมาณค่า stochastic production frontier ภายใต้ฟังก์ชันการตัดสินใจเลือกผลิต.” วารสารเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่ 2 (พฤษภาคม-สิงหาคม) : 33-38.
- ประพนธ์ เฉลิมพิชัย. 2546. การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหุ้นธนาคารพาณิชย์ขนาดใหญ่โดยวิธีการถดถอยแบบสลับเปลี่ยน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- พัชรี เหลืองรุ่งโรจน์. 2546. การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหุ้นในกลุ่มสื่อสารโดยวิธีการถดถอยแบบสลับเปลี่ยน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ภูวดล รัชตศรีประเสริฐ. 2546. การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหุ้นชิ้นส่วนอิเล็กทรอนิกส์โดยวิธีการถดถอยแบบสลับเปลี่ยน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- สุพิมพ์พรรณ พู่เจริญ. 2546. การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหลักทรัพย์บางหลักทรัพย์ในกลุ่มวัสดุก่อสร้างและตกแต่งโดยวิธีการถดถอยแบบสลับเปลี่ยน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- Dickey, D. and Fuller, W. 1979. “Distribution to the Estimates for Autoregressive Time Series with Unit Root.” **Journal of the American Statistical Association** 74.

- Enders, Walter. 1995. **Applied Econometric Time Series**. New York : John Wiley & Sons.
- Fischer, Donald E. and Jordan Ronald J. 1995. **Security Analysis and Portfolio Management**. Englewood Cliffs: NJ: Prentice-Hall International.
- Johnston, Jack and DiNardo, John. 1997. **Econometric Methods**. 4th New York : McGraw – Hill.
- Maddala, G.S. and In-Moo Kim. 1998. **Unit Roots Cointegration and Structural Change**. New York : Cambridge University Press.
- Markowitz, Harry. “Portfolio Selection.” **Journal of Finance** 7 (March 1952) : 77-91.
- Mossin, Jan. “Equilibrium in a Capital Asset Market.” **Econometrica** 34, 4 (October 1966) : 768-784.
- Lintner, J. “The Valuation of Risk Asset and the Selection of Risky Investments in Stock Portfolios and Capital Budget.” **Review of Economics and Statistics** 47, 1 (February 1965) : 13-37.
- Sharpe, William F. “Capital Asset Prices : A theory of Market Equilibrium Under Conditions of Risk.” **Journal of Finance** 19, 3(September 1964) : 425-442.
-